

**UJI KOINTEGRASI DENGAN METODE JOHANSEN
DAN APLIKASINYA PADA DATA HARGA SEMBAKO
DI PASAR INDUK KOTA YOGYAKARTA
(Studi Kasus : Data Harga Daging Sapi dan Daging Ayam Kampung)**

Oleh
David Wahyu Trianto
NIM 09305141030

ABSTRAK

Uji kointegrasi merupakan suatu teknik yang digunakan untuk mengetahui hubungan keseimbangan jangka panjang dari beberapa variabel. Salah satu metode dari uji kointegrasi adalah metode Johansen. Tujuan penulisan skripsi ini adalah menjelaskan prosedur uji kointegrasi dengan metode Johansen dan mengaplikasikannya pada data harga sembako khususnya harga daging sapi dan daging ayam kampung di pasar induk kota Yogyakarta.

Prosedur uji kointegrasi dengan metode Johansen adalah mengidentifikasi data, menguji stasioneritas data, menstasionerkan data, menguji derajat integrasi dan menguji kointegrasi dengan metode Johansen. Uji stasioneritas dapat dilakukan dengan cara metode grafik dan metode *Augmented Dickey Fuller*. Menstasionerkan data dilakukan dengan cara *differencing* sampai data stasioner. Uji kointegrasi Johansen menggunakan dua statistik uji yaitu *trace statistic* dan *maximum eigenvalue*. Cara yang digunakan dalam uji kointegrasi Johansen adalah dengan membandingkan nilai hitung pada statistik uji dengan nilai kritis. Jika nilai hitung statistik uji yaitu *trace statistic* dan *maximum eigenvalue* lebih besar dari nilai kritis maka disimpulkan ada kointegrasi. Program yang digunakan untuk membantu menyelesaikan permasalahan dalam uji kointegrasi dengan metode Johansen adalah *EViews*.

Dalam penulisan skripsi ini dibahas mengenai aplikasi uji kointegrasi dengan metode Johansen pada data harga sembako khususnya daging sapi dan daging ayam kampung di pasar induk kota Yogyakarta. Berdasarkan pembahasan diperoleh kesimpulan bahwa ada kointegrasi atau ada hubungan keseimbangan jangka panjang antara harga daging sapi di tiga pasar yakni Pasar Beringharjo, Pasar Kranggan dan Pasar Demangan. Demikian pula untuk harga daging ayam kampung, ada kointegrasi atau ada hubungan keseimbangan jangka panjang di tiga pasar tersebut. Ini terlihat dari hasil *output* pada program *EViews* yang menunjukkan bahwa nilai statistik uji *trace statistic* dan *maximum eigenvalue* lebih besar dibandingkan dengan nilai kritisnya.

Kata kunci : Uji Kointegrasi Johansen, Stasioneritas, *EViews*, Daging